

# 深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 21 日

送出日期：2024 年 6 月 28 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	建信深证基本面 60ETF	基金代码	159916
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金合同生效日	2011 年 9 月 8 日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2011 年 10 月 24 日
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	薛玲	开始担任本基金基金经理的日期	2017 年 9 月 28 日
		证券从业日期	2013 年 4 月 22 日
其他	场内简称：深 F60ETF		

### 二、基金投资与净值表现

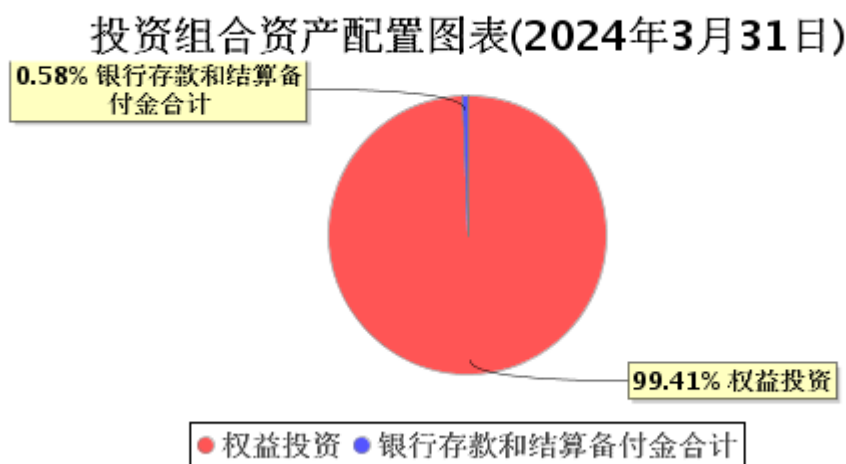
#### (一) 投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》第十一部分了解详细情况

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。其中，基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。
主要投资策略	本基金主要采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在特殊情况下，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 在正常情况下，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪

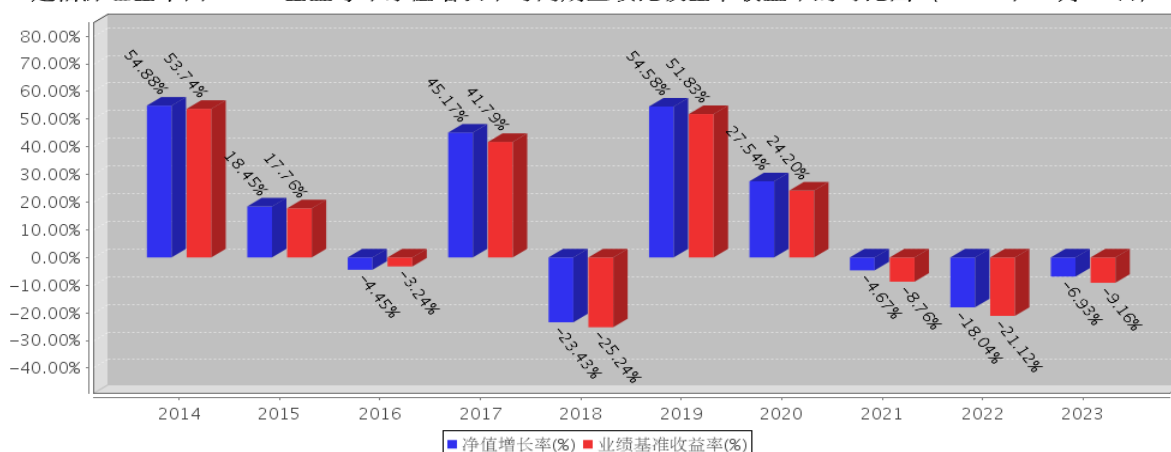
	偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	深证基本面 60 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

建信深证基本面60ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2023年12月31日)



注：基金的过往业绩不代表未来表现。

基金合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费	M ≥ 0 万元		投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可

(前收费)		按照不超过 0.5% 的标准收取佣金
赎回费	$N \geq 0$ 天	投资者在申购或赎回基金份额时, 申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金

注: 场内交易费用以证券公司实际收取为准

## (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率或金额		收取方
管理费	0.50%		基金管理人和销售机构
托管费	0.10%		基金托管人
审计费用	40,000.00 元		会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元		规定披露报刊
指数许可使用费	0.1%	年下限金额: 200,000.00 元	指数编制公司
其他费用	本基金其他费用详见本基金合同或招募说明书费用章节。		相关服务机构

注: 1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负, 按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费、指数许可使用费(若有)为基金整体承担费用, 非单个份额类别费用, 且年金额为预估值, 最终实际金额以基金定期报告披露为准。

## (三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额, 在持有期间, 投资者需支出的运作费率如下表:

基金运作综合费率(年化)
0.74%

注: 基金管理费率、托管费率、销售服务费率(若有)为基金现行费率, 其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险, 投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

标的指数调整成份股或变更编制方法, 标的指数成份股发生送配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化, 成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益, 成份股停牌、摘牌或流动性差等, 法律法规或《基金合同》约定的限制, 本基金可能无法投资于部分标的指数成份股, 基金投资成本、费用及税收, 基金管理人的管理能力, 例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等, 均可能带来基金投资组合回报与标的指数回报偏离。

#### 2、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内, 但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响, 存在不同于基金份额净值的情形, 即存在价格折溢价的风

险。

### 3、投资人申购失败的风险

本基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

### 4、投资人赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失败的情形。

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

### 5、基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

6、本基金可能遇到的风险还包括指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险等。

## (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话：400-81-95533]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料